



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2006

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy Mieszany B

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa	2,544,021.17	3,451,586.11
1.	Lokaty	2,544,021.17	3,424,389.26
2.	Środki pieniężne	0.00	0.00
3.	Należności, w tym	0.00	27,196.85
3.1.	Z tytułu zbycia składników portfela inwestycyjnego	0.00	26,072.13
3.2.	Pozostałe należności	0.00	1,124.72
4.	Pozostałe aktywa	0.00	0.00
II.	Zobowiązania	13,562.29	16,141.23
1.	Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego	3,348.01	1,714.78
2.	Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0.00	0.00
3.	Pozostałe zobowiązania	10,214.28	14,426.45
III.	Aktywa netto (I - II)	2,530,458.88	3,435,444.88



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2006

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy Mieszany B

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	0.00	2,530,458.88
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I - II)	2,318,107.06	307,313.44
I.	Zwiększenia funduszu	2,427,910.35	589,124.43
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	224,327.60	589,124.43
2.	Tytułem udzielonych gwarancji	0.00	0.00
3.	Pozostałe zwiększenia	2,203,582.75	0.00
II.	Zmniejszenia funduszu	109,803.29	281,810.99
1.	Tytułem wykupu	88,203.99	221,099.05
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0.00	0.00
3.	Tytułem opłaty za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	267.87	653.64
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0.00	0.00
5.	Tytułem prowizji od składek	0.00	0.00
6.	Tytułem pozostałych prowizji	0.00	0.00
7.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	21,331.43	53,537.09
8.	Tytułem udzielonych gwarancji	0.00	0.00
9.	Pozostałe zmniejszenia	0.00	6,521.21
C.	Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów)	157,343.95	561,013.04
1.	z papierów emitowanych, poręczonych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	18,267.29	73,649.95
2.	z obligacji emitowanych lub poręczonych przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego	0.00	0.00
3.	z listów zastawnych	855.11	1,052.69
4.	z innych dłużnych papierów wartościowych o stałej stopie dochodu	14,594.12	14,880.69
5.	z innych dłużnych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	0.00	0.00
6.	z akcji	121,585.03	452,943.10
7.	z udziałów	0.00	0.00
8.	z jednostek uczestnictwa lub certyfikatów inwestycyjnych w funduszach inwestycyjnych	0.00	0.00
9.	z innych pochodnych, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	0.00	0.00
10.	z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	0.00	5,510.92
11.	z pożyczek	0.00	9,723.88
12.	z nieruchomości	0.00	0.00
13.	z depozytów bankowych	2,042.40	3,251.81
14.	z lokat dokonanych za pozwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej	0.00	0.00
D.	Pozostałe zwiększenia	55,007.87	36,659.52
E.	Pozostałe zmniejszenia	0.00	0.00
F.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	2,530,458.88	3,435,444.88



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2006

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupy Mieszany B

III. KOSZTY FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Koszty prowadzenia i obsługi rachunków bankowych	149.11	270.44
2.	Koszty nabycia jednostek rozrachunkowych	0.00	0.00
3.	Koszty przechowywania aktywów funduszu	1,660.62	3,158.23
4.	Koszty transakcyjne	63.88	250.17
5.	Koszty zarządzania i administrowania funduszem	19,457.82	49,858.25
6.	Pozostałe koszty	0.00	0.00
7.	RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1 - 6):	21,331.43	53,537.09



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2006

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy Mieszany B

IV. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1.1.	liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	0.000	238,986.974
1.2.	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	238,986.974	273,662.635
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):		
2.1.	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	0.0000	10.5883
2.2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	9.9836	10.5883
2.3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	10.5921	12.6728
2.4.	wartość jednostki rozrachunkowej na koniec okresu sprawozdawczego	10.5883	12.5536



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2006

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy Mieszany B

V. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU

Lokaty		Ilość (w szt.)	Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach funduszu (w %)
1		2	3	4
1.	Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska:		1,645,699.84	47.68%
1.1	Obligacje		1,149,214.24	33.30%
1.1.1	DS0509	21.94	23,468.97	0.68%
1.1.2	DS1013	105.76	106,003.81	3.07%
1.1.3	DS1015	158.50	171,444.72	4.97%
1.1.4	DS1109	40.82	42,493.24	1.23%
1.1.5	DS1110	35.07	36,646.49	1.06%
1.1.6	DZ0109	18.67	19,986.27	0.58%
1.1.7	DZ0110	17.38	18,793.62	0.54%
1.1.8	DZ0709	2.52	2,631.98	0.08%
1.1.9	DZ0811	53.01	53,592.84	1.55%
1.1.10	OK0408	35.07	33,207.24	0.96%
1.1.11	OK1207	14.03	13,514.33	0.39%
1.1.12	PS0310	115.77	124,608.82	3.61%
1.1.13	PS0507	58.33	62,401.51	1.81%
1.1.14	PS0511	105.47	105,178.62	3.05%
1.1.15	PS0608	7.54	7,915.56	0.23%
1.1.16	SP0308	210.39	21,996.73	0.64%
1.1.17	SP1207	210.39	21,310.84	0.62%
1.1.18	WS0922	35.07	37,120.57	1.08%
1.1.19	WZ0911	243.65	246,898.08	7.15%
1.2	Bony skarbowe		496,485.60	14.38%
1.2.1	BS070117	6.96	69,490.67	2.01%
1.2.2	BS070124	4.18	41,663.55	1.21%
1.2.3	BS070221	0.35	3,461.45	0.10%
1.2.4	BS070307	19.19	190,494.65	5.52%
1.2.5	BS070321	5.57	55,212.92	1.60%
1.2.6	BS070808	13.95	136,162.36	3.94%
1.3	Inne		0.00	0.00%
2.	Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego		0.00	0.00%
3.	Listy zastawne		20,405.59	0.59%
3.1	Dopuszczone do publicznego obrotu		20,405.59	0.59%
3.1.1	Notowane na rynku regulowanym		20,405.59	0.59%
3.1.1.1	LZBREPA3100412	20.19	20,405.59	0.59%
3.1.2	Pozostałe		0.00	0.00%
3.2	Niedopuszczone do publicznego obrotu		0.00	0.00%
4.	Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu		395,339.13	11.45%
4.1	Notowane na rynku regulowanym		0.00	0.00%
4.2	Pozostałe		395,339.13	11.45%
4.2.1	Rabobank070305	10.44	103,676.92	3.00%
4.2.2	Rabobank070411	8.35	82,603.54	2.39%
4.2.3	ToyotaBank070529	1.29	126,587.94	3.67%
4.2.4	ToyotaLs070118	5.50	54,884.09	1.59%
4.2.5	VWBank070109	2.13	21,280.05	0.62%
4.2.6	VWLeasing070518	0.64	6,306.59	0.18%
5.	Inne dłużne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu		0.00	0.00%
5.1	Dopuszczone do publicznego obrotu		0.00	0.00%
5.1.1	Notowane na rynku regulowanym		0.00	0.00%
5.1.2	Pozostałe		0.00	0.00%
5.2	Niedopuszczone do publicznego obrotu		0.00	0.00%
6.	Akcje		824,703.19	23.89%
6.1	Dopuszczone do publicznego obrotu		824,703.19	23.89%
6.1.1	Notowane na rynku regulowanym		824,703.19	23.89%
6.1.1.1	I2PIAST	4,747.32	10,206.72	0.30%
6.1.1.2	ABG	539.34	3,829.29	0.11%
6.1.1.3	ACTION	453.86	8,487.14	0.25%
6.1.1.4	AMICA	394.32	11,435.27	0.33%
6.1.1.5	ARTERIA-PDA	20.28	400.45	0.01%
6.1.1.6	ASSECOSLO	29.28	12,004.09	0.35%
6.1.1.7	ATLANTAPL	569.03	9,673.48	0.28%
6.1.1.8	ATM	20.43	3,550.01	0.10%
6.1.1.9	BANKBPH	7.65	7,085.90	0.21%
6.1.1.10	BIOTON	4,055.16	8,840.25	0.26%
6.1.1.11	BRE	19.98	6,713.20	0.19%



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2006

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy Mieszany B

V. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU - CIĄG DALSZY

Lokaty	Ilość (w szt.)	Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach funduszu (w %)
1	2	3	4
6.1.1.12 BZWBK	142.67	32,101.36	0.93%
6.1.1.13 CCIINT	225.50	4,699.41	0.14%
6.1.1.14 CDEC	202.76	17,944.08	0.52%
6.1.1.15 CEZ	344.69	46,532.97	1.35%
6.1.1.16 COMPLAND	49.48	5,081.71	0.15%
6.1.1.17 DEBICA	41.73	3,229.72	0.09%
6.1.1.18 DECORA	402.51	20,306.69	0.59%
6.1.1.19 DGA	29.81	662.87	0.02%
6.1.1.20 DOMDEV	115.67	17,349.80	0.50%
6.1.1.21 DUDA	250.90	3,349.58	0.10%
6.1.1.22 ECHO	90.06	7,970.04	0.23%
6.1.1.23 ELBUDOWA	84.82	9,075.50	0.26%
6.1.1.24 ELDORADO	194.79	16,946.34	0.49%
6.1.1.25 EMAX	13.74	1,580.44	0.05%
6.1.1.26 FAMUR	10.37	4,171.47	0.12%
6.1.1.27 GETIN	1,516.63	19,185.37	0.56%
6.1.1.28 GRAAL	201.69	7,623.79	0.22%
6.1.1.29 GTC	552.21	22,198.74	0.64%
6.1.1.30 HANDLOWY	410.15	35,600.76	1.03%
6.1.1.31 INGBSK	14.68	11,270.88	0.33%
6.1.1.32 INTERCARS	24.33	1,060.83	0.03%
6.1.1.33 JCAUTO	104.07	2,133.47	0.06%
6.1.1.34 KGHM	596.54	53,091.92	1.54%
6.1.1.35 KROSNO	2,364.19	12,955.79	0.38%
6.1.1.36 LENA	578.61	6,121.70	0.18%
6.1.1.37 LOTOS	83.52	4,117.74	0.12%
6.1.1.38 MMPPPL	1,013.79	12,439.20	0.36%
6.1.1.39 MONNARI-PDA	40.55	1,013.79	0.03%
6.1.1.40 MOSTALWAR	165.43	6,782.81	0.20%
6.1.1.41 NFIEMF	523.09	7,035.58	0.20%
6.1.1.42 NORTCOAST	785.54	2,741.54	0.08%
6.1.1.43 OPOCZNO	212.62	8,547.17	0.25%
6.1.1.44 PBG	40.55	10,417.71	0.30%
6.1.1.45 PEKAES	188.52	2,639.28	0.08%
6.1.1.46 PEKAO	185.88	42,177.19	1.22%
6.1.1.47 PEP	1,031.21	15,725.97	0.46%
6.1.1.48 PGF	141.37	11,238.99	0.33%
6.1.1.49 PGNIG	4,302.65	15,489.53	0.45%
6.1.1.50 PKNORLEN	1,520.77	72,540.55	2.10%
6.1.1.51 PKOBP	1,427.65	67,099.63	1.94%
6.1.1.52 POLIMEXMS	44.61	6,781.46	0.20%
6.1.1.53 PROKOM	128.76	17,562.79	0.51%
6.1.1.54 RMFFM	10.21	1,438.26	0.04%
6.1.1.55 SNIEZKA	247.48	9,651.65	0.28%
6.1.1.56 SOFTBANK	171.22	8,595.09	0.25%
6.1.1.57 SPIN	17.84	508.52	0.01%
6.1.1.58 TOORA	863.34	21,410.82	0.62%
6.1.1.59 TPSA	617.67	15,163.80	0.44%
6.1.1.60 VISTULA	40.55	3,649.64	0.11%
6.1.1.61 WILBO	324.41	1,278.19	0.04%
6.1.1.62 ZREW	36.68	13,094.38	0.38%
6.1.1.63 ZYWIEC	2.23	1,090.88	0.03%
6.1.2 Pozostałe		0.00	0.00%
6.2 Niedopuszczone do publicznego obrotu		0.00	0.00%
7. Udziały		0.00	0.00%
8. Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych		0.00	0.00%
8.1 Jednostki uczestnictwa		0.00	0.00%
8.2 Certyfikaty inwestycyjne		0.00	0.00%
8.2.1 Certyfikaty inwestycyjne funduszu inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości		0.00	0.00%
8.2.2 Certyfikaty inwestycyjne innych funduszy inwestycyjnych		0.00	0.00%



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2006

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy Mieszany B

V. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU - CIĄG DALSZY

Lokaty		Ilość (w szt.)	Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach funduszu (w %)
1		2	3	4
9.	Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych		0,00	0,00%
9.1	Opcje		0,00	0,00%
9.2	Kontrakty terminowe		0,00	0,00%
9.3	Swapy walutowe		0,00	0,00%
9.4	Swapy procentowe		0,00	0,00%
9.5	Prawa poboru		0,00	0,00%
9.6	Inne instrumenty pochodne		0,00	0,00%
10.	Inne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu		5,510,92	0,16%
10.1	ATLANTAPL-JPP	570,31	0,00	0,00%
10.2	ĐUDA-JPP	473,94	5,507,16	0,16%
10.3	GRAAL-JPP	201,69	0,00	0,00%
10.4	TETA-JPP	1,39	3,76	0,00%
11.	Pożyczki		0,00	0,00%
11.1	Zabezpieczone hipotecznie		0,00	0,00%
11.2	Zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej		0,00	0,00%
11.3	Pożyczki pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie		0,00	0,00%
11.4	Inne pożyczki		0,00	0,00%
12.	Nieruchomości		0,00	0,00%
13.	Depozyty bankowe		532,730,59	15,43%
13.1	Depozyt O/N	1	532,730,59	15,43%
14.	Inne lokaty za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej		0,00	0,00%
15.	RAZEM LOKATY (SUMA 1-14), W TYM:		3,424,389,26	99,21%
15.1	Ulokowane na terenie RP		3,424,389,26	99,21%
15.2	Ulokowane poza terenem RP, ale na terenie krajów członkowskich UE		0,00	0,00%
15.3	Ulokowane poza terenem RP i UE, ale terenie krajów członkowskich OECD		0,00	0,00%
15.4	Ulokowane poza terenem RP, UE i OECD		0,00	0,00%